



JURUSAN AKUNTANSI

FAKULTAS EKONOMI

UNIVERSITAS ANDALAS

SKRIPSI

**PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP RETURN
SAHAM**

DI BURSA EFEK INDONESIA

OLEH :

SULTHANIKA FALNI

1610536036



*Diajukan Untuk Memenuhi Salah Satu Syarat Guna Memperoleh Gelar Sarjana
Ekonomi Jurusan Akuntansi*

PADANG

2019

	No Alumni Universitas:	Sulthanika Falni	No Alumni Fakultas:
<p align="center">BIODATA :</p> <p>a) Tempat/Tgl Lahir: Padang Panjang, 02 September 1994 b) Nama Orang Tua: Masri Falni dan Yarniliswita c) Fakultas: Ekonomi d) Jurusan: Akuntansi e) No. BP: 1610536036 f) Tanggal Lulus: 15 Juli 2019 g) Predikat lulus: Sangat Memuaskan h) IPK: 3,25 i) Lama Studi: 2 Tahun 11 bulan j) Alamat Orang Tua: Kubu Nan Limo Nagari Batipuh Baruah Kecamatan Batipuh Kabupaten Tanah Datar Sumatera Barat</p>			
<p align="center">PENGARUH HARI PERDAGANGAN TERHADAP RETURN SAHAM DI BURSA EFEK INDONESIA (Studi Kasus Pada Indeks Kompas 100 Yang Terdaftar Di BEI Periode Februari – Juli 2018)</p> <p align="center">Skripsi Oleh Sulthanika Falni Pembimbing Drs. Ilmainir, M.Si, Ak</p> <p align="center">ABSTRACT</p> <p><i>This study aims to provide an explanation of the effect of trading days on the return of company shares listed in The Kompas 100 index on the Indonesian Stock Exchange in 2018.</i></p> <p><i>The target population in this study are all companies in The Kompas 100 indeks on the Indonesian Stock Exchange. After using the purposive sampling, there are 99 companies as target population. Data is collected through secondary data observation methods. Then the method is carried out which includes classic assumption test, descriptive statistical test, and multiple linear regresion analysis include t-test and F-test.</i></p> <p><i>The result of this research show that (1) Partially, The Day Of The Week Effect not have a significant effect on Stock Return, while Week Four Effect do have significant effect on Stock Return, (2) Simultaneously, The Day Of The Week Effect not have a significant effect on Stock Return, while Week Four Effect do have significant effect on Stock Return,</i></p> <p>Keywords: <i>The Day Of The Week Effect, Week Four Effect, Stock Return, Anomaly Market.</i></p>			
<p align="center">ABSTRAK</p> <p>Penelitian ini bertujuan untuk memberikan penjelasan mengenai pengaruh hari perdagangan terhadap <i>return</i> saham perusahaan yang terdaftar dalam indeks Kompas 100 di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2018.</p> <p>Target populasi dalam penelitian ini adalah semua perusahaan dalam indeks Kompas 100 di Bursa Efek Indonesia Setelah dilakukannya <i>purposive sampling</i> terdapat 99 perusahaan yang dapat dijadikan objek dalam penelitian ini. Data dikumpulkan melalui metode observasi data sekunder. Metode analisis data yang digunakan meliputi</p>			

uji asumsi klasik, uji statistik deskriptif, serta analisis regresi linear berganda termasuk uji t dan uji F.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa (1) secara *parsial* variabel *The Day Of The Week Effect* tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham, sedangkan variabel *Week Four Effect* memiliki pengaruh terhadap *return* saham. (2) secara simultan, variabel *The Day Of The Week Effect* tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham, sedangkan variabel *Week Four Effect* memiliki pengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci: *The Day Of The Week Effect*, *Week Four Effect*, Return Saham, Anomali Pasar.

Skripsi ini telah dipertahankan di depan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada tanggal 15 Juli 2019. Abstrak ini telah disetujui oleh pembimbing dan penguji:

TandaTangan		
NamaTerang	Drs. Ilmainir, M.Si, Ak	Dra. Warnida, MM, Ak, CA

Mengetahui:

Ketua Program Studi Intake Akuntansi: **Dra. Warnida, MM, Ak, CA**
NIP. 19651118 199203 2 003

Tanda Tangan

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus:

	Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama:	Tanda Tangan
No. Alumni Universitas	Nama:	Tanda Tangan

